

Räntekonsortiet

Räntekonsortiet vänder sig till investerare som vill investera i svenska räntepapper med hög kreditkvalitet. Konsortiets jämförelseindex är OMRX All 1-3 och förvaltningen kan jämföras med bankernas räntefonder. Resultatet har över lång tid varit bättre än jämförelseindex med en god riskjusterad avkastning.

Avkastningsmål och investeringspolicy

Målsättningen för konsortiet är att skapa en god avkastning och samtidigt investera i värdepapper med hög kreditkvalitet och begränsad ränterisk. Valet av värdepapper i ränteportföljen är ett prioriterat område och konsortiet innehåller normalt en hög andel säkerställda bostadsobligationer samt företagsobligationer av hög kreditkvalitet. Lägsta tillåtna kreditkvalitet är BBB-. Ränterisken begränsas genom att den genomsnittliga löptiden är cirka två år. Med långsiktiga strategier och låg omsättningshastighet är målet att erbjuda en bättre avkastning än jämförelseindex samt nå en hög riskjusterad avkastning motsvarande en informationskvot på 0,2.

Ansvarsfulla investeringar

Kapitalförvaltningen ser ekonomisk, ekologisk och social hållbar utveckling som förutsättning för god avkastning och långsiktig tillväxt. Konsortiet tar hänsyn till internationella normer och riktlinjer för miljö, socialt ansvar och ägarstyrning i valet av aktier. I konsortiet finns restriktioner kring placeringar i företag med verksamheter inom pornografi, tobak, fossil energi, alkohol, spel samt vapen. Konsortiet följer Kapitalförvaltningens policy för ansvarsfulla investeringar.

Läs mer om detta och om övriga tjänster på:
www.kammarkollegiet.se/kapitalforvaltning

Kapitalförvaltningens tjänster

Förvaltning

Förvaltning av svenska och utländska aktier och obligationer.

Allokering

Marknadsläget ständiga förändringar kräver en optimalt sammansatt portfölj. Med vår expertis i allokering garanteras du en stabil kombination mellan olika tillgångsslag.

Juridik

De juridiska tjänster som vi utför för våra uppdragskunder är anpassade efter kundens krav och behov. En hög kvalitet på juridisk kompetens spelar en viktig roll för våra kunders framgång.

Ekonomitjänster

Kammarkollegiet kan bli din finansavdelning som tar hand om allt från förvaltning till redovisning, deklarationer, administration och riskkontroll.

Värdepappersadministration VPA

VPA utför back- och middle officetjänster för både externt och internt förvaltad kapital från myndigheter, stiftelser och statliga bolag. VPA ansvarar också för avkastnings- och riskrapportering samt resultatuppföljning.

Finansiell rådgivning

Vår rådgivning syftar till att hjälpa våra kunder att få en effektiv och bra förmögenhetsförvaltning. Rådgivningen är oberoende och inriktad på att sätta mål kring avkastning, risknivå, tillgångsallokering och portföljstrategi.

Riskmätt (SEK)



Låg risk

Medelrisk

Hög risk

Förmögenhet

	Total
Förmögenhet (tkr) 2024 03 31	3 745 012
Förmögenhet föregående månad (tkr)	3 602 533
Förmögenhet (tkr) 2023 12 31	3 531 655
Andelar klass A (antal) 2024 03 31	22 746 853
Andelsvärde, klass A inkl. utdelning	113,45
Andelsvärde, klass A exkl. utdelning	112,56
Andelar klass B (Antal) 2024 03 31	10 240 868
Andelsvärde, klass B inkl. utdelning	113,66
Andelsvärde, klass B exkl. utdelning	112,76

Avkastning (jämförelseindex)

Sedan årets början (%)	0,04 (- 0,19)
1 år (%)	3,84 (3,56)
3 år (%)	0,70 (0,01)
5 år (%)	2,19 (0,25)

Nyckeltal (jämförelseindex)

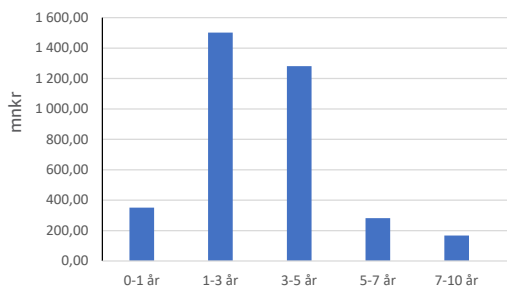
Standardavvikelse (%)* 1,64	(1,71)
Sharpekvot* 0,40	(0,16)
Informationskvot*	0,68
Informationskvot 12-månaderstal	0,57
Tracking error (%)*	0,56
Tracking error 12-månaderstal (%)	0,49
Duration	3,31

*Nyckeltalen är beräknade utifrån månadsavkastningar som rullande 5-årstal.

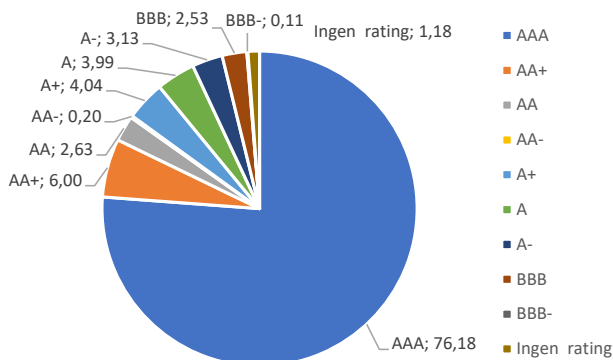
Räntekonsortiet

Största enskilda innehav	Andel (%)	Marknadsvärde (kr)
Sparebanken Vest Boligkreditt 4.09% 280929	8,6	317 326 333
Sweden Inflation Linked Bond 1% 250601 #3109	5,8	215 429 221
Svensk Exportkredit 3.375% 260318	5,4	200 173 000
Kommuninvest 3% 290312 #2903	4,6	170 215 900
Danske Hypotek 3.5% 271215 #2712	4,1	153 339 000
Danske Bank ADJ 260303	4,1	151 208 192
Sweden Inflation Linked Bond 0.125% 271201 #3113	4,1	149 950 768
Sveriges Sakerställda Obligationer 2% 260617 #147	4,0	148 301 833
Kommuninvest 0.75% 260204 #2602	3,9	143 516 875
Kommuninvest 3.25% 291112 #2911	3,9	143 368 283

Förfallostruktur



Kreditrating



Avkastning januari - mars

